

工行金融市场：人民币汇率市场上周概览

(2021年3月1日-3月5日)

◆ 人民币汇率市场上周概览

- 人民币外汇即期汇率：人民币中间价上周五（3月5日）报 6.4904，较前周贬值约 0.29%。银行间外汇市场人民币对美元汇率较前周贬值约 0.27%，上周最高 6.4561、最低 6.4830，收于 6.4768，波幅为 0.42%。上周境内人民币汇率整体贬值，受近期美债收益率明显上行、中美利差有所收窄等因素影响。预计本周人民币汇率可能小幅走弱，整体在 6.4500 ~ 6.5500 区间浮动。
- 人民币外汇掉期市场：市场交投一般活跃，各期限掉期点震荡下行，截至上周五 16:30，中长期限方面，1 年期限美元对人民币掉期点较前周下行 36 个点，上周最高 1690、最低 481，收于 1663，波幅为 72.70%。
- 境外人民币无本金交割远期（NDF）汇率：1 年期境外美元对人民币无本金交割远期（NDF）较前周上行 356 个点，上周最高 6.6995、最低 6.6194，收于 6.6858，波幅为 1.20%。

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。

表 1：境内美元对人民币汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较上月 末 (点)	较去年 末 (点)
即期汇率						
中间价	—	—	6.4904	191	191	-345
银行间市场汇价	6.4830	6.4561	6.4768	178	178	-630
掉期点						
1 个月期限	174	148	149	-10	-10	19
2 个月期限	320	297	301	-13.5	-13.5	28.5
3 个月期限	455	429	441	-16	-16	56
6 个月期限	883	851	858	-20	-20	118
1 年期限	1690	481	1663	-36	-36	232

数据来源：路透

表 2：境外美元对人民币无本金交割远期 (NDF) 汇率变动

	最高价	最低价	收盘价	较前周 (点)	较去年末 (点)	与境内价 差 (点)
1 个月期限	6.5406	6.4704	6.5283	336	21	169
2 个月期限	6.5574	6.4853	6.5443	331	61	177
3 个月期限	6.5716	6.4990	6.5583	341	71	177
6 个月期限	6.6151	6.5374	6.6013	331	143	190
1 年期限	6.6995	6.6194	6.6858	356	266	230

数据来源：路透

免责声明：本研究报告由中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）撰写，研究报告所引用信息均来自公开资料，所载观点不代表工商银行立场。我们力求但不保证这些信息的准确性和完整性。对于任何因使用或信赖本晨报信息而造成（或声称造成）的任何直接或间接损失，我们不承担任何责任。本报告版权仅为工商银行所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、刊登、发表或引用。工商银行保留对任何侵权行为进行追究的权利。